

## 投資信託・債券部門 最優秀会社賞 受賞のお知らせ

### ～リフィニティブ・リッパー・ファンド・アワード 2021 ジャパン～

【2021年3月18日】

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（代表取締役社長：高村 孝）は、「リフィニティブ・リッパー・ファンド・アワード 2021 ジャパン」の「投資信託・債券」部門において最優秀会社賞を受賞いたしましたので、お知らせいたします。

当社では、今回の受賞を励みに、今後ともより一層の運用力と商品開発力の向上を目指してまいります。引き続きお引き立て賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズについて

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズは、過去40年にわたり、各国政府や機関投資家、金融プロフェッショナルの皆様にご提供しています。厳密なリサーチや分析、厳しいマーケット環境における経験を礎としたリスク考慮型アプローチをもとに、アクティブからインデックス戦略まで幅広く、コスト効率に優れたソリューションを提案いたします。そしてスチュワード（受託者）として、社会、環境への配慮が長期的な成果をもたらすということをお客様に理解を深めていただくよう努めています。インデックス運用とETF、ESG投資の先駆者として、投資における新しい世界を常に切り拓き、約3.47兆ドル\*を運用する世界第3位の資産運用会社へと成長しました。ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズは、ステート・ストリート・コーポレーションの資産運用部門です。

\*運用資産残高には、約751.7億ドル(2020年12月末時点)のステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ファンズ・ディストリビューターズ・エルエルシー（以下「SSGA FD」）が取り扱っているSPDRの残高を含みます。SSGA FDはSSGAの関連会社です。

## リフィニティブ・リップパー・ファンド・アワードについて

世界の 20 カ国以上で 30 年余りにわたり、高く評価されている Refinitiv Lipper Fund Awards は、独自の投資信託評価システム「Lipper Leader Rating（リップパー・リーダー・レーティング）システム」の中の「コンシスタント・リターン（収益一貫性）」を用い、優れたファンドとその運用会社を選定し、表彰するものです。評価方法の詳細につきましては、<https://lipperalpha.refinitiv.com/lipper/>をご覧ください。

## 評価対象基準（すべて満たすもの）

- 評価年の 12 月末時点で、該当国で販売登録されているファンドを評価対象と致します。
- 評価年の 12 月末時点で、36 ヶ月以上の運用実績があるファンドが評価対象と致します。
- 評価翌年の 4 月 1 日以降に償還を迎えるファンドを評価対象と致します。
- リPPER・グローバル分類を用い、代表的なシェアクラスのファンドを基準に、10 本以上（確定拠出年金部門は 5 本以上）のファンドが存在する分類を評価対象と致します（それ以外の分類、機関投資家向けファンドやその他の非リテール・ファンド、プライベート・ファンド、クローズド・エンド型ファンド、ETF（上場投資信託）、保険ファンド、指数連動型ファンドを除く）。
- 資産クラス別では、不動産型を除く、株式型、債券型、ミックスアセット型、コモディティ型、オルタナティブ型、絶対収益型ファンド型の、各資産クラスを投資対象とするファンドを評価対象と致します。
- 確定拠出年金部門の対象ファンドは、確定拠出年金専用ファンドと致します。

**最優秀会社評価方法（資産クラス別部門）** \* 確定拠出年金部門の評価方法は小規模運用会社の基準を採用

資産クラス別部門では、規模別に最優秀会社を選定いたします。それぞれの資産クラスにおいて、少なくとも 5 つの株式、5 つの債券、3 つのミックスアセットのポートフォリオを有する大規模運用会社が、最優秀会社賞の対象となります。小規模運用会社は、資産クラスの 1 つ（株式、債券、またはミックスアセット）において、少なくとも 3 つの異なるポートフォリオを運用している必要があります。資産クラスおよび運用会社ごとに、該当ファンドの平均値にてランク付けし（十分位数）、評価期間 3 年間の「コンシスタント・リターン」を基にした評価を行い、最優秀会社賞を選定いたします。ファンドの平均値が同一の結果の場合、パーセンタイル・ランク（上位何パーセントに位置するか）の平均が低い運用会社に授与いたします。

## リフィニティブ・リップパーについて

リフィニティブ・リップパーは、総合投資情報、投資信託、退職年金基金、ヘッジファンド、及び手数料とコストに関する独立した洞察を、資産管理会社、ファイナンシャル・アドバイザーと機関投資家の皆様に提供しています。高品質なデータ、投信評価情報、分析ツール、及びコメタリーを通じ、投資信託市場参加

者の皆様から、40年以上にわたる信用を受け、リップパーは他に類のない専門知識と洞察を投資信託業界に提供しています。

リフィニティブ・リップパー・ファンド・アワードは毎年、多くのファンドのリスク調整後リターンを比較し、評価期間中のパフォーマンスが一貫して優れているファンドと運用会社を表彰いたします。

選定に際しては、「Lipper Leader Rating（リップパー・リーダー・レーティング）システム」の中の「コンシスタント・リターン（収益一貫性）」を用い、評価期間3年、5年、10年でリスク調整後のパフォーマンスを測定いたします。評価対象となる分類ごとに、コンシスタント・リターンが最も高いファンドにリフィニティブ・リップパー・ファンド・アワードが贈られます。詳しい情報は、<https://lipperalpha.refinitiv.com/lipper/>をご覧ください。Refinitiv Lipper は、本資料に含まれるデータの正確性・信頼性を確保するよう合理的な努力をしていますが、それらの正確性については保証しません。

- 本資料は金融商品取引法上及び投信法上の開示書類ではありません。
- 本資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社が情報提供を目的として作成したものであり、投資の勧誘を目的とするものではありません。
- 本資料の内容は作成日現在のものであり、将来予告なく変更することがあります。
- 本資料の著作権は当社にあります。外部第三者への開示、転載、複写などにつきましてはこれを固く禁じます。

## ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

東京都港区虎ノ門1-23-1 虎ノ門ヒルズ森タワー25階  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第345号

加入協会：一般社団法人 日本投資顧問業協会、一般社団法人 投資信託協会、日本証券業協会